

ABSTRAK

Noor khumaidah, 1950110072, “Pengaruh *Monday Effect*, *Weekend Effect* dan *Pre-Holiday Effect* Pada Saham Yang Terdaftar Di JII Terhadap *Return Saham* (Studi Saham Bank Syariah Indonesia Periode Februari 2021 - Desember 2022)”.

Penelitian ini bertujuan untuk menguji dan menganalisis pengaruh *Monday effect* terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia, pengaruh *Weekend effect* terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia, dan pengaruh *Pre-holiday effect* terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia.

Jenis penelitian ini menggunakan penelitian kausalitas dengan pendekatan kuantitatif. Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah saham yang tercatat dalam indeks saham syariah JII selama periode Februari 2021 - Desember 2022 dengan teknik pengambilan sampel berdasarkan pertimbangan khusus (*purposive sampling*) dengan kriteria saham likuid yang terdaftar di JII, saham yang termasuk sektor perbankan di JII, dan saham sektor perbankan yang tercatat di JII selama periode 2021 – 2022, sehingga sampel yang ada pada penelitian ini adalah saham Bank Syariah Indonesia. Analisis data yang digunakan pada penelitian ini adalah uji statistik deskriptif, uji asumsi klasik, uji regresi linier sederhana. Data diolah menggunakan bantuan SPSS versi 25.

Hasil penelitian menyatakan bahwa variabel *Monday effect* berpengaruh terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia. Variabel *Weekend effect* tidak berpengaruh terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia. Variabel *Pre-holiday effect* tidak berpengaruh terhadap *return* saham Bank Syariah Indonesia.

Kata kunci: *Monday effect*, *Weekend effect*, *Pre-holiday effect* dan *Return saham*.